

# Central Daily Market Report

2022年1月21日(金)  
セントラル短資株式会社 総合企画部

## ●資金需給

単位：億円	2022年1月21日 需給速報	2022年1月24日 需給予想	2022年1月25日 当社予想
銀行券	700	600	1,000
財政	2,100	▲ 2,100	24,000
資金過不足	2,800	▲ 1,500	25,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	13,600		
CP等買入		▲ 100	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入		▲ 100	▲ 200
新型コロナ対応金融支援特別			
気候変動対応オペ			
E T F 買入	300		
国債補充供給		300	
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	16,800	▲ 1,800	25,800
当座預金残高	5,353,500	5,351,700	5,377,500
準備預金残高	4,725,200		
積み終了先	4,724,900	1月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,724,700	積数	3,600
非準備預金先	628,300	1日平均	200
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			3,779,800
準備預金進捗率	実績	99.90%	日数
			25.81%

## ●2022年1月21日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.07~▲0.008%の調達で始まった。引き続き、地銀を中心に調達ニーズが強いことに加え、3日積み要因もあり、レートは前日比で上昇した。ターム物はショートタームの出合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲0.08%程度での出合い。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

### <短国市場>

21日はTB3M物(第1053回)の入札が実施され、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、底堅く推移した。

### <CP市場>

CP市場は、大型を含めて複数の業態から入札が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/1/21	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.086	0.130	▲ 0.010	27,522.26	▲ 250.67	113.98-00	113.86-87
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.003	▲ 0.008				-	▲ 0.087						
2W			▲ 0.008				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.015	▲ 0.012	▲ 0.013				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.095	▲ 0.102						
6M							▲ 0.100	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.099	▲ 0.126						
									日付	1/14	1/17	1/18	1/19	1/20
									日銀当預残	5,349,100	5,325,500	5,355,400	5,363,400	5,336,700
									準備預金残	4,762,800	4,718,500	4,745,400	4,745,700	4,710,100
									マネタリーベース	6,598,700	6,573,200	6,601,000	6,607,500	6,580,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.029%	▲ 0.028%	▲ 0.026%	▲ 0.025%
									コール市場残高	166,843	187,487	190,486	187,904	193,896
									うち無担	147,946	170,003	173,166	170,660	177,040
									うちO/N	82,393	103,465	102,723	100,407	105,427
									うち有担	18,897	17,484	17,320	17,244	16,856

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1053	-	50,000	2022/1/24	2022/4/25	136,812.0	40,667.1	100.0220	▲0.0882%	63.4443%	100.0229	▲0.0918%	9,332	
流動性供給	350	-	5,000	2022/1/24		17,555.0	4,993.0		▲0.0170%	10.1289%		▲0.0200%		
交付税特会	-	-	11,000	2022/2/1	2022/8/2	465,301.0	10,990.36		0.0000%	2.3620%		0.0000%		10.00

## ●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/1/21	2022/1/24	▲ 0.350	44	44		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/21	2022/1/24	▲ 0.350	0	0				

## ●2022年1月24日の予定

\*国庫短期証券(1054回)入札  
(6ヶ月、34,500億円、1/25発行)

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入